

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2015

Fecha de Información: 23 de noviembre de lunes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1540.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	253.2	276.2	215.9	197.2	20.3	16.0	40.0
15-35	484.4	431.0	158.5	205.9	23.4	29.5	249.0
36-60	119.9	139.6	28.0	0.0	51.6	59.9	60.0
61-90	3.2	5.0	1.5	0.0	3.5	3.2	0.0
91-180	3.1	88.0	4.0	0.0	84.0	3.1	0.0
>180	78.7	51.9	0.0	28.0	6.9	5.7	45.0
Total	942.5	991.6	407.9	431.1	189.7	117.4	394.0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.0 %	1.5 %	0.2 %	0.6 %
15-35	0.3 %	0.7 %	-0.3 %	0.2 %
36-60	1.5 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	3.3 %	2.5 %	2.9 %
91-180	-	4.6 %	2.6 %	4.6 %
>180	4.3 %	4.9 %	4.4 %	4.4 %
Total	0.9 %	2.1 %	0.8 %	1.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de noviembre				30 de nov. al 4 de diciembre				7 al 11 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	166	3490	3224	13	83	3427	3027	13	188	1656	1847
Intragruppo y off-shore***	0	0	1622	1079	0	0	1600	1552	0	0	1094	479
Otros	166	24	692	1502	83	13	773	1221	188	13	441	864
Total	191	191	5804	5804	97	97	5800	5800	201	201	3190	3190

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.